

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-07-05】

今日 Fixing 定在 7.1289，较上一交易日下调了 16 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

短端，O/N 成交在 -21.5~-18.5 的位置；T/N 成交在 -7.33~-6.9 的位置；S/N 成交在 -7.32~-7.22 的位置。1w 较多成交在 -52.2，-52.1，-51.9 的位置；2w 成交在 -105.1，-104.4 的位置；3w 成交在 -159.5 的位置；1s 成交在 -235.3，-235 的位置；2s 成交在 -480 的位置；3s 成交在 -722 的位置，成交寡淡；4s 成交在 -1001 的位置。

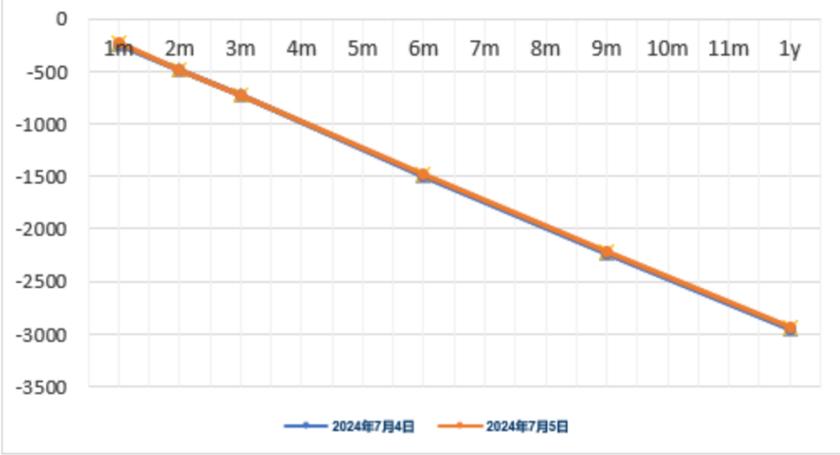
中长期，6s 成交主要成交 -1480 的位置；9s 成交在 -2222，-2220 的位置；1y 今日成交较多，开盘在 -2944 的位置，较多成交在 -2939，-2928 的位置，尾盘收在 -2930 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -53 的位置；2w*3w 成交在 -53 的位置；2w*1s 成交在 -130.5 的位置；3w*1s 成交在 -77.5 的位置；2s*3s 成交在 -242.5 的位置；3s*4s 成交在 -276.5 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.2622	0.5
2W	14	-104	7.2570	1
1M	31	-235	7.2439	2.9
2M	62	-482	7.2193	11
3M	92	-723	7.1951	6.4
6M	184	-1478	7.1196	10
9M	274	-2218	7.0456	16
1Y	365	-2930	6.9744	20
18M	549	-4100	6.8574	35
2Y	730	-4975	6.7699	55
3Y	1095	-6095	6.6579	80
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1289	
CLOSING SPOT RATE			7.2674	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-246.6	-487.7	-1243.1	-1983.1	-2695.1
2M		-241.1	-996.5	-1736.5	-2448.5
3M			-755.4	-1495.4	-2207.4
6M				-740	-1452
9M					-712

Fx Swap Curve



文 / Edward Sun

联系人: Rafael Wang
邮箱: rafael.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和/或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN